



【2023-2-28】

今天人民币兑美元中间价报 6.9519，较上一交易日上调 53 个基点。

期权 ATM 方面，on 成交 75pips，1m 成交 5.7，3m 成交 5.3、5.35 和 5.28，6m 成交 5.05 和 5.1，9m 成交 4.9，1y 成交 4.9

RR 方面，3m 25d 成交 0.85，3m 10d 成交 1.3，9m 25d 成交 0.84，9m 10d 成交 1.6

FLY 方面（25d），2m 成交 0.255，9m 成交 0.27

Vanilla 方面，on 6.9550 call 成交在 20、30 和 35pips，2w 7.0 call 成交在 110pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP		
2/28/2023	6.9519	-53
ATM	Traded	Changes
1w	5.0 / 6.5	
2w	5.0 / 6.5	
1s	5.0 / 6.0	5.7
2s	4.8 / 5.8	
3s	4.8 / 5.8	5.3, 5.35, 5.28
6s	4.3 / 5.3	5.05, 5.1
9s	4.3 / 5.0	4.9
1y	4.3 / 5.0	4.9
2y	4.5 / 6.5	
3y	4.5 / 6.5	
25d RR	Traded	changes
1s	0.5 / 1.0	
2s	0.5 / 1.0	
3s	0.5 / 1.0	0.85
6s	0.5 / 1.0	
9s	0.5 / 1.1	0.84
1y	0.5 / 1.1	
25d FLY	Traded	changes
1w	0.2 / 0.5	
1s	0.2 / 0.5	
2s	0.2 / 0.5	0.255
3s	0.2 / 0.5	
6s	0.2 / 0.5	
9s	0.2 / 0.5	0.27
1y	0.2 / 0.5	

文 / Daisy dai

联系人：Rafael Wang
邮箱：rafael.wang@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明：

以上所含及附加的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，且为保密的和/或者专用的信息。其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）或第三方，“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据，也不保证其完整性、时效性或准确性等要求，且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN